



وزارة التعليم العالي والبحث العلمي
الجامعة المستنصرية
كلية الادارة والاقتصاد

نموذج دالة التحويل العشوائي ثلاثي المتغيرات بمدخلات مستقلة مع تطبيق عملي

رسالة مقدمة الى مجلس

كلية الادارة والاقتصاد - الجامعة المستنصرية وهي
جزء من متطلبات نيل درجة ماجستير علوم في الاعطاء

تقدمت بها الطالبة
سولاف صبري لفته الساعدي

باشراف الاستاذ المساعد
الدكتور جواد كاظم خضير الموسوي

2012 ميلادية

1433 هجرية

المخلص

ان نماذج دالة التحويل العشوائي تلعب دوراً مهماً في تحليل السلاسل الزمنية متعددة المتغيرات ، فهي تعد من الموضوعات التي لها اهمية تطبيقية في المجالات الاقتصادية والصناعية وغيرها . فقد تناولت هذه الدراسة احد هذه النماذج التي تتضمن ثلاث سلاسل زمنية وهي : سلسلتان مستقلتان كمدخلات وسلسلة واحدة كمخرجات .

وعليه فإن الهدف الرئيس لهذه الرسالة هو اجراء دراسة مكثفة لخصائص نماذج السلاسل الزمنية متعددة المتغيرات وبشكل خاص ثلاثية المتغيرات بأستخدام انموذج دالة التحويل العشوائي الذي نوقش بالتفصيل في ظل مواصفات الانموذج التصادفي .

لقد طبقت هذه الدراسة على بيانات شهرية لثلاث سلاسل زمنية تتمثل بمعدل سعر الصرف للدينار العراقي تجاه الدولار الامريكي ، فجوة الطلب للعملة الاجنبية ، ومبيعات العملة الاجنبية . وقد تم التوصل من خلال مقارنة الانموذج المدروس الذي يسمى اختصاراً **DISO** مع نماذج اخرى مقترحة وهي : انموذج **ARMA** أحادي المتغيرات وانموذجان لدالة التحويل بمدخلات احادية ومخرجات احادية الذي يسمى اختصاراً **SISO** ، وتبين ان الانموذج المدروس كان الافضل اعتماداً على المعايير **NBIC,NAIC,MSE** .